



KINEA INFRA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS DE INFRAESTRUTURA		
MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 31 DE MARÇO DE 2021		
Analistas	Pedro Gomes Felipe Biquero	+55 11 4504 2604 +571 484 6770

Data de Emissão do Fundo	ISIN	TIPO DE FUNDO	AUM	CLASSE DE ATIVOS	PAIS	MOEDA	RATING ATUAL	ÚLTIMA AÇÃO DE RATING	AÇÃO
27/04/2017		FIDC	2,714,764,280.68	Debêntures Incentivadas	Brasil	BRL	'AA+ff(bra)'	9/10/2020	Rating Elevado de 'AAf(bra)' para 'AA+ff(bra)'

IMPACTO DO CENÁRIO DE ESTRESSE DO CORONAVÍRUS	ALÉM DA ANÁLISE REGULAR DAS MÉTRICAS DO RATING, A FITCH TAMBÉM ANALISOU A SENSIBILIDADE DO FUNDO A UMA DETERIORAÇÃO DA QUALIDADE DE CRÉDITO DOS INVESTIMENTOS SUBJACENTES COMO RESULTADO DA EXPOSIÇÃO A SETORES CONSIDERADOS SENSÍVEIS A UM AMBIENTE OPERACIONAL PRESSIONADO RESULTANTE DE UMA EXTENSÃO DAS MEDIDAS DE CONTENÇÃO DO CORONAVÍRUS. ESSA ANÁLISE NÃO EVIDENCIOU EXPOSIÇÃO MATERIAL A ESSES FATORES, NEM POTENCIAL DETERIORAÇÃO RELEVANTE DO RATING DE QUALIDADE DE CRÉDITO DA CARTEIRA. COMO RESULTADO, AS MÉTRICAS DO FUNDO PERMANECERAM CONSISTENTES COM UMA CLASSIFICAÇÃO DE QUALIDADE DE CRÉDITO 'AA+ff(bra)'.
---	---

PARTES DA TRANSAÇÃO		RATING
Gestor	Kinea Investimentos Ltda.	N.A.
Administrador	Banco Itaú Unibanco S.A.	AAA(bra)
Controladoria	Banco Itaú Unibanco S.A.	AAA(bra)
Custodiante	Banco Itaú Unibanco S.A.	AAA(bra)

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 31 DE MARÇO DE 2021

COMPOSIÇÃO DOS ATIVOS

FIDC I (FIDC II foi incorporado pelo FIDC I)

TÍTULOS													
RATING	TIPO DE TÍTULO	ISIN/CÓDIGO	EMISSION	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DE EMISSÃO	DATA DO VENCIMENTO	TAXA DE REFERÊNCIA (Índice se é taxa fixa ou a taxa de referência)	MOEDA	VALOR DE MERCADO	DURATION	DURATION MODIFICADA	
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD8008/ASCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)	69,954,000.00	28/04/2017	28-Apr-17	15-Oct-30	8.00%	BRL	83,074,917.18	4.95	na	G144945
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD8008/ASCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)	5,174,336.64	12/09/2017	28-Apr-17	15-Oct-30	8.00%	BRL	5,937,824.65	4.95	na	G263987
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD8008/ASCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)	34,191,828.65	20/10/2017	28-Apr-17	15-Oct-30	6.71%	BRL	40,377,207.65	4.95	na	G298242
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSEHD8002/ASEH11	Ventos de Santo Estevão Holding S.A.	5,899,000.00	07/11/2017	7-Nov-17	15-Jul-32	6.99%	BRL	6,565,717.09	6.20	na	G310785
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAMMD8008/TMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletric	91,461,000.00	23/07/2018	23-Jul-18	15-Mar-36	8.28%	BRL	117,504,753.74	7.30	na	G527281
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD8008/ASCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)	7,665,981.27	14/02/2019	28-Apr-17	15-Oct-30	6.05%	BRL	8,194,198.02	4.95	na	G690435
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAMMD8008/TMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletric	19,626,852.74	27/02/2019	23-Jul-18	15-Mar-36	6.66%	BRL	21,171,437.41	7.30	na	G700567
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUD8013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S	5,142,164.01	27/02/2019	3-Oct-18	15-Dec-30	5.60%	BRL	5,541,815.58	4.81	na	G700572
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSESD8006/SESE11	Sobral I Solar Energia SPE S.A	111,389,541.02	03/03/2019	19-Oct-18	15-Dec-33	6.12%	BRL	113,839,957.65	5.38	na	G701125
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD8008/ASCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)	7,918,183.60	03/04/2019	28-Apr-17	15-Oct-30	6.03%	BRL	8,312,954.52	4.95	na	G727940
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD8008/ASCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)	16,892,184.78	11/04/2019	28-Apr-17	15-Oct-30	6.17%	BRL	17,813,473.96	4.95	na	G734513
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEED8005/TAEE26	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	320,918.07	24/05/2019	24-May-19	15-May-44	5.92%	BRL	404,345.77	10.71	na	G770453
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD8008/ASCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)	19,508,002.85	21/10/2019	28-Apr-17	15-Oct-30	4.47%	BRL	19,453,501.13	4.95	na	G899017
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRECPND8006/ECPN11	Concessionária Ponte Rio Niterói S.A. - Ecopont	1,119,000.00	19/11/2019	19-Nov-19	15-Oct-34	4.40%	BRL	1,141,624.90	7.74	na	G924277
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTSPD8006/TPSP11	Central Fotovoltaica São Pedro II S.A.	2,000,000.00	06/12/2019	6-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	1,938,778.27	6.02	na	G939498
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPVD8006/SPV11	Central Fotovoltaica São Pedro V S.A.	2,000,000.00	11/12/2019	11-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	1,935,980.76	6.02	na	G943706
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEED8011/TAEE18	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	194,853.32	17/01/2020	17-Jan-20	15-Dec-44	4.99%	BRL	202,025.13	10.42	na	G974509
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUD8013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S	1,200,328.85	07/07/2020	3-Oct-18	15-Dec-30	4.11%	BRL	1,198,692.27	4.81	na	H116616
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUD8013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S	999,866.60	07/07/2020	3-Oct-18	15-Dec-30	4.11%	BRL	998,503.34	4.81	na	H116695
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVP1ED8000/VP1E11	Vila Piauí 1 Empreendimentos e Participações S	11,113,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	10,869,405.56	4.98	na	H137189
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVP1ED8000/VP1E11	Vila Piauí 1 Empreendimentos e Participações S	1,776,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	1,737,070.48	4.98	na	H137214
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPVD8000/SPV111	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	2,043,880.86	30/07/2020	6-Mar-20	15-Jul-44	5.31%	BRL	2,068,576.49	8.03	na	H137229
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVP2ED8008/VP2E11	Vila Piauí 2 Empreendimentos e Participações S	12,456,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	13,294,096.42	5.05	na	H137253
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSEHD8002/ASEH11	Ventos de Santo Estevão Holding S.A.	212,254.99	19/08/2020	7-Nov-17	15-Jul-32	5.36%	BRL	209,244.15	6.20	na	H153184A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSEHD8002/ASEH11	Ventos de Santo Estevão Holding S.A.	188,547.44	19/08/2020	7-Nov-17	15-Jul-32	5.36%	BRL	185,874.68	6.20	na	H153185A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD8008/ASCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)	398,543.16	19/08/2020	28-Apr-17	15-Oct-30	4.33%	BRL	395,459.12	4.95	na	H153186A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD8008/ASCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)	298,009.75	19/08/2020	28-Apr-17	15-Oct-30	4.33%	BRL	295,703.67	4.95	na	H153187A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCLD8008/ASCL11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSC11)	298,009.75	19/08/2020	28-Apr-17	15-Oct-30	4.33%	BRL	295,703.67	4.95	na	H153188A
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUD8013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S	994,677.59	19/08/2020	3-Oct-18	15-Dec-30	4.14%	BRL	985,076.03	4.81	na	H153189A
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUD8013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S	994,677.59	19/08/2020	3-Oct-18	15-Dec-30	4.14%	BRL	985,076.03	4.81	na	H153190A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGD8017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	706,901.21	19/08/2020	5-Nov-19	15-Oct-29	3.84%	BRL	648,597.33	4.01	na	H153198A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGD8017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	1,085,448.89	19/08/2020	5-Nov-19	15-Oct-29	3.84%	BRL	995,923.12	4.01	na	H153199A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGD8017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	601,284.31	19/08/2020	5-Nov-19	15-Oct-29	3.84%	BRL	551,691.52	4.01	na	H153200A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCEPEP8000/CEPE12	Copacabana Geração de Energia e Participações	596,671.79	19/08/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	5.13%	BRL	585,274.57	5.47	na	H153201A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCEPEP8000/CEPE12	Copacabana Geração de Energia e Participações	447,793.37	19/08/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	5.13%	BRL	439,238.94	5.47	na	H153202A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCEPEP8000/CEPE12	Copacabana Geração de Energia e Participações	596,671.79	19/08/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	5.13%	BRL	585,274.57	5.47	na	H153203A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCEPEP8000/CEPE12	Copacabana Geração de Energia e Participações	298,138.37	20/08/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	5.11%	BRL	292,071.26	5.47	na	H155563
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUD8013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S	298,801.20	20/08/2020	3-Oct-18	15-Dec-30	4.11%	BRL	295,400.74	4.81	na	H155565
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSUD8013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S	995,180.84	20/08/2020	3-Oct-18	15-Dec-30	4.11%	BRL	983,855.37	4.81	na	H155566

AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletric	496,125.72	20/08/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	4.86%	BRL	463,795.67	7.30	na	H155575
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVCLDBS008/VSLC11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSLC11)	994,982.62	20/08/2020	28-Apr-17	15-Oct-30	4.31%	BRL	985,678.89	4.95	na	H155576
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVCLDBS008/VSLC11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSLC11)	497,491.31	20/08/2020	28-Apr-17	15-Oct-30	4.31%	BRL	492,839.45	4.95	na	H155577
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletric	841,077.41	20/08/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	4.86%	BRL	786,268.57	7.30	na	H155578
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVCLDBS008/VSLC11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSLC11)	497,491.31	20/08/2020	28-Apr-17	15-Oct-30	4.31%	BRL	492,839.45	4.95	na	H155579
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVCLDBS008/VSLC11	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSLC11)	497,491.31	20/08/2020	28-Apr-17	15-Oct-30	4.31%	BRL	492,839.45	4.95	na	H155580
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPVDBS000/SPVL11	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	971,000.00	06/03/2020	6-Mar-20	15-Jul-44	5.33%	BRL	1,004,291.89	8.03	na	H17200
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTRPDBS002/TRP113	Tropicália Transmissora de Energia S.A.	103,818,629.94	17/02/2020	26-Jul-20	15-Aug-43	4.62%	BRL	105,317,747.39	9.69	na	H1999
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGDBS017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	1,305,955.02	21/10/2020	5-Nov-19	15-Oct-29	3.93%	BRL	1,361,478.72	4.01	na	H206819
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBS011/TAEI18	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	1,567,580.15	15/03/2021	17-Jan-20	15-May-44	4.26%	BRL	1,966,714.65	10.71	na	H206831
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVNYDDBS018/ANYD12	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	3,216,694.40	21/10/2020	17-Jan-20	15-Dec-44	5.51%	BRL	3,358,667.80	10.42	na	H206833
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVNYDDBS018/ANYD12	Vineyards Transmissão de Energia S.A.	1,052,127.77	21/10/2020	15-Aug-19	15-Jul-42	5.87%	BRL	1,082,078.67	8.00	na	H206842
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVGHDBS002/VSEH11	Ventos de Santo Estevão Holding S.A.	37,260,592.77	04/12/2020	7-Nov-17	15-Jul-32	3.35%	BRL	35,338,450.17	6.20	na	H245314
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletric	74,953,000.00	23/07/2018	23-Jul-18	15-Mar-36	8.28%	BRL	96,296,058.51	7.30	na	H249509
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletric	3,500,183.62	05/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	3,396,885.76	7.30	na	H249510
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletric	623,822.15	15/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.13%	BRL	603,833.70	7.30	na	H249511
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCEPDBS000/CEP12	Copacabana Geração de Energia e Participações	16,204,000.00	21/09/2018	24-Sep-18	15-Apr-33	8.47%	BRL	18,343,886.13	5.47	na	H249512
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCEPDBS000/CEP12	Copacabana Geração de Energia e Participações	1,116,681.94	09/09/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	5.12%	BRL	1,099,220.41	5.47	na	H249513
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	40,680,000.00	03/10/2018	3-Oct-18	15-Dec-30	7.39%	BRL	49,656,620.68	4.81	na	H249514
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSEDDBS006/RISE11	Sobral I Solar Energia SPE S.A.	1,424,609.89	01/03/2019	19-Oct-18	15-Dec-33	6.12%	BRL	1,455,821.45	5.38	na	H249515
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTRPDBS002/TRP113	Tropicália Transmissora de Energia S.A.	1,000,000.00	26/07/2019	26-Jul-19	15-Aug-43	5.09%	BRL	1,121,020.76	9.69	na	H249517
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BREGVGDBS017/EGVG21	Enel Green Power Volta Grande S.A.	1,981,240.00	05/11/2019	5-Nov-19	15-Oct-29	3.90%	BRL	1,918,927.02	4.01	na	H249519
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCEPNDDBS006/ECPN11	Concessionária Ponte Rio-Niterói S.A. - Ecopont	2,000,000.00	19/11/2019	19-Nov-19	15-Oct-34	4.40%	BRL	2,040,437.72	7.74	na	H249520
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSDBS006/TPSP11	Central Fotovoltaica São Pedro II S.A.	52,854,000.00	06/12/2019	6-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	51,236,099.29	6.02	na	H249522
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPVDBS006/SPVL11	Central Fotovoltaica São P edro IV S.A.	2,000,000.00	11/12/2019	11-Dec-19	15-Dec-34	4.40%	BRL	1,935,980.76	6.02	na	H249523
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBS011/TAEI18	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	1,927,099.33	17/01/2020	17-Jan-20	15-Dec-44	4.99%	BRL	1,998,028.54	10.42	na	H249524
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS057/EREN13	Eren Drcena Participações S.A. (1ª série)	6,690,000.00	19/02/2020	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	6,246,358.80	6.78	na	H249525
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS073/EREN23	Eren Drcena Participações S.A. (1ª 2ªrie)	1,974,000.00	19/02/2020	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	1,855,058.16	6.80	na	H249524
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPVDBS000/SPVL11	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	25,000,000.00	06/03/2020	6-Mar-20	15-Jul-44	5.33%	BRL	25,857,206.14	8.03	na	H249527
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVPZEDBS008/VPZE11	Vila Piaui 2 Empreendimentos e Participações S	1,011,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	998,835.57	5.05	na	H249529
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVPLEDBS000/VPLE11	Vila Piaui 1 Empreendimentos e Participações S	989,000.00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5.95%	BRL	967,321.34	4.98	na	H249530
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRARCVDBS037/ARCV12	Arcoverde Transmissão de Energia S.A.	209,079.01	15/03/2021	27-Sep-19	15-Jul-42	5.46%	BRL	204,381.94	7.12	na	H330809
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCEPNDDBS006/ECPN11	Concessionária Ponte Rio-Niterói S.A. - Ecopont	1,392,698.62	15/03/2021	19-Nov-19	15-Oct-34	5.01%	BRL	1,360,971.96	7.74	na	H330812
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS057/EREN13	Eren Drcena Participações S.A. (1ª série)	1,781,751.05	15/03/2021	19-Feb-20	15-Sep-37	5.44%	BRL	1,746,926.36	6.78	na	H330813
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPVDBS006/SPVL11	Central Fotovoltaica São P edro IV S.A.	667,474.82	15/03/2021	11-Dec-19	15-Dec-34	5.05%	BRL	657,265.47	6.02	na	H330814
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRFTPSDBS006/FTSP11	Central Fotovoltaica São Pedro II S.A.	768,836.07	15/03/2021	6-Dec-19	15-Dec-34	5.04%	BRL	757,092.91	6.02	na	H330815
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSEDDBS006/RISE11	Sobral I Solar Energia SPE S.A.	3,434,458.05	15/03/2021	19-Oct-18	15-Dec-33	5.14%	BRL	3,393,379.74	5.38	na	H330816
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS073/EREN23	Eren Drcena Participações S.A. (1ª 2ªrie)	542,576.88	15/03/2021	19-Feb-20	15-Sep-37	5.34%	BRL	531,896.11	6.80	na	H330817
AA+(bra)	Deb. Infraestrutura	BRSPVDBS000/SPVL11	SPE Transmissora de Energia Linha Verde II S.A.	2,119,207.86	15/03/2021	6-Mar-20	15-Jul-44	5.91%	BRL	2,066,576.49	8.03	na	H330818
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTRPDBS002/TRP113	Tropicália Transmissora de Energia S.A.	2,666,011.07	15/03/2021	26-Jul-20	15-Aug-43	5.27%	BRL	2,601,889.18	9.69	na	H330821
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBS011/TAEI18	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	2,818,262.13	15/03/2021	17-Jan-20	15-Dec-44	5.45%	BRL	2,749,562.03	10.42	na	H330822
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTAEEDBS057/TAEI26	Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	5,527,156.90	15/03/2021	24-May-19	15-May-44	4.26%	BRL	5,589,839.65	10.71	na	H330823
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVNYDDBS018/ANYD12	Vineyards Transmissão de Energia S.A.	3,760,537.60	15/03/2021	15-Aug-19	15-Jul-42	6.16%	BRL	3,722,853.45	8.00	na	H330824
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVPZEDBS000/VPZE11	Vila Piaui 1 Empreendimentos e Participações S	499,793.76	15/03/2021	30-Jul-20	15-Jun-35	6.70%	BRL	493,930.51	4.98	na	H330826
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVPZEDBS008/VPZE11	Vila Piaui 2 Empreendimentos e Participações S	516,959.47	15/03/2021	30-Jul-20	15-Jun-35	6.48%	BRL	510,779.42	5.05	na	H330827
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS057/EREN13	Eren Drcena Participações S.A. (1ª série)	37,786,000.00	19/02/2020	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	35,240,256.15	6.78	na	H4770
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDBS073/EREN23	Eren Drcena Participações S.A. (1ª 2ªrie)	10,878,000.00	19/02/2020	19-Feb-20	15-Sep-37	4.70%	BRL	10,222,554.52	6.80	na	H4773
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletric	604,769.75	13/05/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.89%	BRL	617,965.98	7.30	na	H71890
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTPSDBS013/TPSU12	Guaraciaba Transmissora de Energia (TP SUL) S.	1,799,539.54	13/05/2020	3-Oct-18	15-Dec-30	5.33%	BRL	1,855,409.62	4.81	na	H71920
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCEPDBS000/CEP12	Copacabana Geração de Energia e Participações	4,411,325.61	13/05/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	6.34%	BRL	4,737,667.46	5.47	na	H71941
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCEPDBS000/CEP12	Copacabana Geração de Energia e Participações	499,781.53	13/05/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	6.34%	BRL	534,331.91	5.47	na	H71943
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCEPDBS000/CEP12	Copacabana Geração de Energia e Participações	10,563,004.25	05/06/2020	24-Sep-18	15-Apr-33	5.18%	BRL	10,680,977.88	5.47	na	H91153
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletric	3,000,073.30	05/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.17%	BRL	4,852,510.41	7.30	na	H91161
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRTMMDBS008/TJMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Eletric	889,278.38	15/06/2020	23-Jul-18	15-Mar-36	5.13%	BRL	860,784.21	7.30	na	H95958A
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVCLDBS024/VSLC12	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSLC12)	2,386,000.00	09/04/2020	9-Apr-20	15-Dec-29	7.06%	BRL	2,786,766.76	4.02	na	H249528
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCLGEDBS009/CLGE11	Caldeirão Grande Energias Renováveis S.A.	28,000,000.00	15/12/2020	15-Dec-20	15-Dec-31	6.59%	BRL	27,833,387.02	4.69	na	H254457
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRBANDBS013/BRAN12	BRK Ambiental - Centro Norte Participações S.A	28,500,000.00	30/12/2020	30-Dec-20	28-Dec-25	4.00%	BRL	28,917,440.59	4.31	na	H267245
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCLGEDBS009/CLGE11	Caldeirão Grande Energias Renováveis S.A.	5,076,584.78	17/03/2021	15-Dec-20	15-Dec-31	7.37%	BRL	5,014,979.91	4.69	na	H333020
AA-(bra)	Deb. Infraestrutura	BRCLGEDBS009/CLGE11	Caldeirão Grande Energias Renováveis S.A.	106,122.45	24/03/2021	15-Dec-20	15-Dec-31	7.79%	BRL	106,363.30	4.69	na	H340033
AAA(bra)	Deb. Infraestrutura	BRVCLDBS024/VSLC12	Ventos de São Clemente Holding S.A. (VSLC12)	9,000,000.00	09/04/2020	9-Apr-20	15-Dec-29	7.06%	BRL	10,511,693.57	4.02	na	H46626
AA-(bra)	NTN-8	BRSTNONTB3D4	Tesouro Nacional	2,351,375.78	14/12/2020	15-Jul-60	15-Aug-50	3.89%	BRL	2,208,815.60	16.23	na	H253398
AA-(bra)	NTN-8	BRSTNONTB3D4	Tesouro Nacional	3,130,793.11	05/01/2021	15-Jul-60	15-Aug-50	3.81%	BRL	2,871,465.48	16.23	na	H270160
AA-(bra)	NTN-8	BRSTNONTB3D4	Tesouro Nacional	11,007,731.48	09/02/2021	15-Jul-60	15-Aug-50	3.92%	BRL	10,160,570.16	16.23	na	H301055
AA-(bra)	NTN-8	BRSTNONTB3D4	Tesouro Nacional	5,041,773.03	19/03/2021	15-Jul-60	15-Aug-50	4.26%	BRL	4,940,338.27	16.23	na	H331965
AA-(bra)	NTN-8	BRSTNONTB3D4	Tesouro Nacional	1,127,113.97	24/03/2021	15-Jul-60	15-Aug-50	4.48%	BRL	1,139,750.91	16.23	na	H339331

FUNDOS DE INVESTIMENTO																											
RATING		TIPO DE FUNDO		GESTORA		FUNDO		VALOR NOMINAL		DATA DA COMPRA		DATA DO VENCIMENTO		MOEDA		VALOR DE MERCADO											
CAIXA		N.A.																									
RATING		TIPO DE TÍTULO				ENTIDADE								MOEDA		VALOR DE MERCADO											
AA(bra)		Op Compromissada (NTN OVER)				Tesouro Nacional								BRL		27,870,610.88											
		SALDO EM TESOURARIA RESERVA												BRL		4,336.98											
		Contas a pagar												BRL		(84,232.76)											
OPERAÇÕES NO MERCADO MONETÁRIO (REPOS)																											
POSICÃO		TIPO DE OPERAÇÃO		ISIN/CÓDIGO TÉCNICO SUBJACENTE		EMISSOR SUBJACENTE		VALOR NOMINAL		DATA DA COMPRA		DATA DE EMISSÃO SUBJACENTE		DATA DO VENCIMENTO SUBJACENTE		TAXA DE REFERÊNCIA (Indique se é taxa fixa ou a taxa de referência)		MOEDA		VALOR DE MERCADO		CONTRAPARTE		DATA DE VENCIMENTO DA OPERAÇÃO			
		N.A.																									
DERIVATIVOS																											
POSICÃO		TIPO DE OPERAÇÃO		ISIN SUBJACENTE		EMISSOR SUBJACENTE		VALOR NOMINAL		DATA DA COMPRA		DATA DE EMISSÃO SUBJACENTE		DATA DO VENCIMENTO SUBJACENTE		TAXA DE REFERÊNCIA (Indique se é taxa fixa ou a taxa de referência)		MOEDA		VALOR DE MERCADO		TIPO DE OPERAÇÃO		TIPO DO DERIVATIVO		CÓDIGO TÉCNICO	
		N.A.																									

MONITORAMENTO TRIMESTRAL - INFORMAÇÕES DE 31 DE MARÇO DE 2021

COMPOSIÇÃO DOS ATIVOS

FIDC V

TÍTULOS

RATING	TIPO DE TÍTULO	ISN/CÓDIGO	EMISOR	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DE EMISSÃO	DATA DO VENCIMENTO	TAXA DE REFINANCIAMENTO (Indique se é taxa fixa ou a taxa de referência)	MOEDA	VALOR DE MERCADO	DURATION	DURATION MODIFICADA
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRPV1EBDS000/VP1E11	Vila Piaú 1 Empreendimentos e Participações S.A.	734.000,00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5,95%	BRL	717.910,89	4,98	na
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRPVEDEBS000/VP2E11	Vila Piaú 2 Empreendimentos e Participações S.A.	750.000,00	30/07/2020	30-Jul-20	15-Jun-35	5,95%	BRL	740.975,94	5,05	na
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRPVEVDS000/VP3V11	Transmissora de Energia Linha Verde S.A.	60.154.000,00	06/03/2020	6-Mar-20	62.167.075,14	8,03%	BRL	62.167.075,14	8,03	na
AA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRPVEBDS013/TP3U11	Transmissora Brasileira de Energia (TP 3) S.A.	2.966.623,05	3-04-18	3-Apr-18	2.935.487,43	4,81%	BRL	2.935.487,43	4,81	na
AA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDS065/EREN13	Eren Draçena Participações S.A. (1ª série)	1.872.000,00	19/02/2020	15-Sep-37	1.747.860,04	6,78%	BRL	1.747.860,04	6,78	na
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRERENDS073/EREN23	Eren Draçena Participações S.A. (1ª série)	428.000,00	19/02/2020	19-Feb-20	402.211,19	6,80%	BRL	402.211,19	6,80	na
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRITMDS0008/ITMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Brito	1.051.114,14	05/06/2020	23-Jun-36	1.000.090,38	7,30%	BRL	1.000.090,38	7,30	na
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRITMDS0008/ITMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Brito	1.399.279,16	05/06/2020	15-Mar-36	1.357.983,45	5,17%	BRL	1.357.983,45	5,17	na
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRITMDS0008/ITMM11	Transmissora José Maria de Macedo de Brito	112.818,90	15/06/2020	23-Jun-18	110.281,36	5,13%	BRL	110.281,36	5,13	na
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRITMDS0009/COG111	Caldeirão Grande Transmissora Renováveis S.A.	3.750.000,00	12/02/2020	12-Feb-20	3.750.396,23	0,00%	BRL	3.750.396,23	0,00	na
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRKKNMDS019/BRKN12	BRK Ambiental - Centro Norte Participações S.J.	3.500.000,00	30/12/2020	30-Dec-20	3.800.931,66	4,31%	BRL	3.800.931,66	4,31	na
AAA(Bra)	Deb. Infraestrutura	BRVSCNDS024/VSC12	Vento do Sol Clemente Holding S.A. (VSC12)	1.000.000,00	09/04/2020	9-Apr-20	1.167.965,95	7,06%	BRL	1.167.965,95	7,06	na
AA(Bra)	NTN-B	BRVSCNNTN7B04	Vento do Sol Nacional	351.375,78	15-Aug-20	15-Aug-20	2.208.819,60	16,23%	BRL	2.208.819,60	16,23	na
AA(Bra)	NTN-B	BRVSCNNTN7B04	Tesouro Nacional	2.282.401,42	08/03/2021	15-Dec-20	2.208.819,60	4,14%	BRL	2.208.819,60	16,23	na

FUNDOS DE INVESTIMENTO

RATING	TIPO DE FUNDO	GESTORA	FUNDO	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DO VENCIMENTO	MOEDA	VALOR DE MERCADO
--------	---------------	---------	-------	---------------	----------------	--------------------	-------	------------------

CAIXA

RATING	TIPO DE TÍTULO	ENTIDADE	MOEDA	VALOR DE MERCADO
AA(bra)	Op Comprissada (NTN OVER)	Tesouro Nacional	BRL	6,860,807.64
	SALDO EM TESOUREARIA RESERVA		BRL	2,657.17
	Contas a pagar		BRL	(23,992.63)

OPERAÇÕES NO MERCADO MONETÁRIO (REPOS)

POSICÃO	TIPO DE OPERAÇÃO	ISIN/CÓDIGO TÉCNICO SUBJACENTE	EMISSION SUBJACENTE	VALOR NOMINAL	DATA DA COMPRA	DATA DE EMISSÃO SUBJACENTE	DATA DO VENCIMENTO SUBJACENTE	TAXA DE REFERÊNCIA (Indique se é taxa fixa ou a taxa de referência)	MOEDA	VALOR DE MERCADO	CONTRAPARTE	DATA DE VENCIMENTO DA OPERAÇÃO
---------	------------------	--------------------------------	---------------------	---------------	----------------	----------------------------	-------------------------------	---	-------	------------------	-------------	--------------------------------

DERIVATIVOS

[illegible]